

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 1, 3 PfandBG

Umlaufende Pfandbriefe und dafür verwendete Deckungswerte

1. Quartal 2024

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Hypothekendarfandbriefe	(Mio. €)	35.076,0	33.527,4	33.167,6	30.391,6	31.371,6	27.481,4
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	41.358,0	40.259,9	40.260,2	38.091,5	37.981,8	34.483,8
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	6.282,0	6.732,5	7.092,7	7.699,8	6.610,2	7.002,4
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,9	20,1	21,4	25,3	21,1	25,5
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	1.420,4	1.357,8	663,4	1.243,4		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	4.861,6	5.374,7	6.429,3	6.456,5		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	6.282,0	6.732,5	7.092,7	7.699,8		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		17,9	20,1	21,4	25,3		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

Gesamtbetrag der im Umlauf befindlichen		Nominalwert		Barwert		Risikobarwert*	
		Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023	Q1 2024	Q1 2023
Öffentlichen Pfandbriefe	(Mio. €)	9.244,4	9.323,4	9.596,0	9.519,6	9.043,7	8.434,1
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.606,7	12.443,4	11.971,1	12.532,0	11.196,1	11.083,9
darunter Derivate	(Mio. €)	-	-	-	-	-	-
Überdeckung	(Mio. €)	2.362,3	3.120,1	2.375,1	3.012,4	2.152,3	2.649,8
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,6	33,5	24,8	31,6	23,8	31,4
Gesetzliche Überdeckung ¹	(Mio. €)	367,9	375,9	191,9	378,2		
Vertragliche Überdeckung ²	(Mio. €)	-	-	-	-		
Freiwillige Überdeckung ³	(Mio. €)	1.994,4	2.744,2	2.183,2	2.634,2		
Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells	(Mio. €)	2.362,3	3.120,1	2.375,1	3.012,4		
Überdeckung in % vom Pfandbrief-Umlauf		25,6	33,5	24,8	31,6		

* Für die Berechnung des Risikobarwertes wurde der dynamische Ansatz gem. § 5 Abs. 1 Nr. 2 PfandBarwertV verwendet.

¹ Nach dem

Nominalwert: Summe aus der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG und des Nennwerts der barwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG

Barwert: Barwertige sichernde Überdeckung gemäß § 4 Abs. 1 PfandBG

² Vertraglich zugesicherte Überdeckung

³ Residual, in Abhängigkeit der gesetzlichen und vertraglichen Überdeckung; Barwert enthält den Barwert der nennwertigen sichernden Überdeckung gemäß § 4 Abs. 2 PfandBG

Hinweis: Die Überdeckung unter Berücksichtigung des vdp-Bonitätsdifferenzierungsmodells ist optional.

Laufzeitstruktur der umlaufenden Pfandbriefe und der dafür verwendeten Deckungsmassen
1. Quartal 2024

Hypothekendarlehen	Q1 2024		Q1 2023		Q1 2024	Q1 2023
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	2.021,9	2.228,9	889,0	1.891,2	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	1.031,5	2.158,2	2.053,0	1.912,0	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	2.377,0	2.194,7	1.581,9	1.779,3	2.021,9	889,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	3.048,0	2.827,5	776,5	1.773,2	1.031,5	2.053,0
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	4.576,5	4.491,3	5.139,0	4.452,1	5.425,0	2.358,4
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	3.655,9	3.590,1	4.568,5	3.972,8	4.576,5	5.139,0
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	3.182,0	3.845,0	2.654,9	3.421,4	3.655,9	4.568,5
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	10.974,3	12.382,6	11.162,5	13.153,2	12.391,0	13.147,4
> 10 Jahre	4.208,9	7.639,7	4.702,0	7.904,7	5.974,2	5.372,0

Öffentliche Pfandbriefe	Q1 2024		Q1 2023		Q1 2024	Q1 2023
	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Pfandbriefumlauf Mio. €	Deckungsmasse Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €	Fäv (12 Monate)* Pfandbriefumlauf Mio. €
Restlaufzeit:						
<= 0,5 Jahre	492,1	650,0	357,0	721,8	-	-
> 0,5 Jahre und <= 1 Jahr	550,6	573,7	427,8	614,7	-	-
> 1 Jahr und <= 1,5 Jahre	577,0	481,8	490,3	601,2	492,1	357,0
> 1,5 Jahre und <= 2 Jahre	465,9	693,5	450,6	541,6	550,6	427,8
> 2 Jahre und <= 3 Jahre	723,0	942,5	1.053,2	1.141,4	1.042,9	940,9
> 3 Jahre und <= 4 Jahre	1.061,9	963,8	743,0	896,4	723,0	1.053,2
> 4 Jahre und <= 5 Jahre	507,3	791,3	560,9	934,2	1.061,9	743,0
> 5 Jahre und <= 10 Jahre	1.704,5	2.708,2	1.964,2	2.902,8	1.989,8	1.972,5
> 10 Jahre	3.162,0	3.801,9	3.276,4	4.089,3	3.384,0	3.829,0

Informationen zur Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe

	Q1 2024	Q1 2023
Voraussetzungen für die Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.	Das Hinausschieben der Fälligkeit ist erforderlich, um die Zahlungsfähigkeit der Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit zu vermeiden (Verhinderung der Zahlungsfähigkeit), die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit ist nicht überschuldet (keine bestehende Überschuldung) und es besteht Grund zu der Annahme, dass die Pfandbriefbank mit beschränkter Geschäftstätigkeit jedenfalls nach Ablauf des größtmöglichen Verschiebungszeitraums unter Berücksichtigung weiterer Verschiebungsmöglichkeiten ihre dann fälligen Verbindlichkeiten erfüllen kann (positive Erfüllungsprognose). Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2b PfandBG.
Befugnisse des Sachwalters bei Verschiebung der Fälligkeit der Pfandbriefe	Der Sachwalter kann die Fälligkeiten der Tilgungszahlungen verschieben, wenn die maßgeblichen Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG hierfür erfüllt sind. Die Verschiebungsdauer, welche einen Zeitraum von 12 Monaten nicht überschreiten darf, bestimmt der Sachwalter entsprechend der Erforderlichkeit. Der Sachwalter kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entscheidet sich der Sachwalter für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderlegbar vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen. Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe einer Emission nur einheitlich Gebrauch machen. Hierbei dürfen die Fälligkeiten vollständig oder anteilig verschoben werden. Der Sachwalter hat die Fälligkeit für eine Pfandbriefemission so zu verschieben, dass die ursprüngliche Reihenfolge der Bedienung der Pfandbriefe, welche durch die Verschiebung überholt werden könnten, nicht geändert wird (Überholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fällig werdender Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2a und 2b PfandBG.	Der Sachwalter kann die Fälligkeiten der Tilgungszahlungen verschieben, wenn die maßgeblichen Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG hierfür erfüllt sind. Die Verschiebungsdauer, welche einen Zeitraum von 12 Monaten nicht überschreiten darf, bestimmt der Sachwalter entsprechend der Erforderlichkeit. Der Sachwalter kann die Fälligkeiten von Tilgungs- und Zinszahlungen, die innerhalb eines Monats nach seiner Ernennung fällig werden, auf das Ende dieses Monatszeitraums verschieben. Entscheidet sich der Sachwalter für eine solche Verschiebung, wird das Vorliegen der Voraussetzungen nach § 30 Abs. 2b PfandBG unwiderlegbar vermutet. Eine solche Verschiebung ist im Rahmen der Höchstverschiebungsdauer von 12 Monaten zu berücksichtigen. Der Sachwalter darf von seiner Befugnis für sämtliche Pfandbriefe einer Emission nur einheitlich Gebrauch machen. Hierbei dürfen die Fälligkeiten vollständig oder anteilig verschoben werden. Der Sachwalter hat die Fälligkeit für eine Pfandbriefemission so zu verschieben, dass die ursprüngliche Reihenfolge der Bedienung der Pfandbriefe, welche durch die Verschiebung überholt werden könnten, nicht geändert wird (Überholverbot). Dies kann dazu führen, dass auch die Fälligkeiten später fällig werdender Emissionen zu verschieben sind, um das Überholverbot zu wahren. Siehe ergänzend auch § 30 Absatz 2a und 2b PfandBG.

* Auswirkungen einer Fälligkeitsverschiebung auf die Laufzeitstruktur der Pfandbriefe / Verschiebungsszenario: 12 Monate. Es handelt sich hierbei um ein äußerst unwahrscheinliches Szenario, welches erst nach Ernennung eines Sachwalters zur Geltung kommen könnte.

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

1. Quartal 2024

Deckungswerte	Q1 2024 Mio. €	Q1 2023 Mio. €
Bis einschließlich 300 Tsd. €	10.558,7	10.139,5
Mehr als 300 Tsd. € bis einschließlich 1 Mio. €	3.338,2	3.062,9
Mehr als 1 Mio. € bis einschließlich 10 Mio. €	9.903,1	10.167,0
Mehr als 10 Mio. €	16.528,1	15.817,4
Summe	40.328,0	39.186,9

Zur Deckung von Öffentlichen Darlehen verwendete Forderungen nach Größengruppen

1. Quartal 2024

Deckungswerte	Q1 2024 Mio. €	Q1 2023 Mio. €
Bis einschließlich 10 Mio. €	5.389,4	5.649,6
Mehr als 10 Mio. € bis einschließlich 100 Mio. €	3.955,5	4.298,1
Mehr als 100 Mio. €	2.261,8	2.495,8
Summe	11.606,7	12.443,4

Zur Deckung von Hypothekendarlehen verwendete Forderungen nach Gebieten, in denen die beliehenen Grundstücke liegen und nach Nutzungsart sowie Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt.

1. Quartal 2024

Deckungswerte																Gesamt- betrag der mindestens 90 Tage rückstän- digen Leistungen	Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
Staat	1. Quartal	Insgesamt		Wohnwirtschaftlich					Gewerblich					Mio. €	Mio. €		
		Mio. €	Mio. €	Insgesamt	davon				Insgesamt	davon							
					Eigentums- wohnungen	Ein- und Zwei- familien- häuser	Mehrfamilien- häuser	Unfertige und noch nicht ertragfähige Neubauten		Bauplätze	Bürogebäude	Handels- gebäude	Industrie- gebäude				
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	40.328,0	23.470,1	2.766,4	8.174,1	12.309,6	182,1	37,9	2.685,5	7.950,0	5.392,6	1.251,1	1.975,4	107,9	181,0	-	-
	Jahr 2023	39.186,9	22.727,9	2.420,4	7.667,7	12.337,2	273,7	28,9	16.459,0	7.527,1	4.363,7	211,6	4.116,1	191,7	48,9	-	-
Deutschland	Jahr 2024	38.820,7	23.461,8	2.766,4	8.173,9	12.301,5	182,1	37,9	15.358,9	7.054,5	5.047,7	1.075,8	1.900,0	99,9	181,0	-	-
	Jahr 2023	37.885,8	22.719,5	2.420,4	7.667,3	12.329,2	273,7	28,9	15.166,2	6.729,4	4.033,5	211,6	3.959,0	183,9	48,9	-	-
Frankreich	Jahr 2024	439,9	8,2	0,0	0,1	8,0	-	-	431,8	202,1	141,1	88,6	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	278,1	8,2	0,0	0,2	8,0	-	-	269,8	153,8	116,1	-	-	-	-	-	-
Großbritannien	Jahr 2024	280,2	-	-	-	-	-	-	280,2	265,4	6,8	-	-	8,0	-	-	-
	Jahr 2023	229,5	-	-	-	-	-	-	229,5	212,5	9,3	-	-	7,7	-	-	-
Niederlande	Jahr 2024	680,4	0,1	-	0,1	-	-	-	680,3	423,7	105,1	77,0	74,5	-	-	-	-
	Jahr 2023	685,6	0,1	-	0,1	-	-	-	685,5	427,2	111,9	-	146,5	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2024	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	4,3	-	9,7	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	14,0	-	-	-	-	-	-	14,0	4,3	-	-	9,7	-	-	-	-
Polen	Jahr 2024	43,4	-	-	-	-	-	-	43,4	-	43,4	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	43,4	-	-	-	-	-	-	43,4	-	43,4	-	-	-	-	-	-
Schweden	Jahr 2024	49,4	-	-	-	-	-	-	49,4	-	48,5	-	0,9	-	-	-	-
	Jahr 2023	50,5	-	-	-	-	-	-	50,5	-	49,5	-	1,0	-	-	-	-

Zur Deckung von Öffentlichen Pfandbriefen verwendete Forderungen

1. Quartal 2024

Deckungswerte											
		Summe		davon geschuldet von				davon gewährleistet von			
		in der Summe enthaltene Gewährleistungen aus Gründen der Exportförderung		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige	Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	11.606,7	-	595,4	1.804,4	8.002,6	550,4	269,1	316,7	66,5	1,5
	Jahr 2023	12.443,4	-	595,4	2.180,4	8.545,5	614,0	95,9	320,6	89,9	1,9
Deutschland	Jahr 2024	10.219,5	-	26,0	1.241,7	7.965,7	486,5	269,1	162,5	66,5	1,5
	Jahr 2023	10.858,2	-	26,0	1.425,1	8.507,3	545,2	95,9	167,1	89,9	1,9
Belgien	Jahr 2024	68,0	-	45,0	23,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	68,0	-	45,0	23,0	-	-	-	-	-	-
Frankreich	Jahr 2024	40,0	-	40,0	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	40,0	-	40,0	-	-	-	-	-	-	-
Italien	Jahr 2024	102,9	-	10,0	87,9	5,0	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	110,9	-	10,0	95,2	5,7	-	-	-	-	-
Luxemburg	Jahr 2024	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	7,4	-	7,4	-	-	-	-	-	-	-
Österreich	Jahr 2024	442,0	-	417,0	25,0	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	442,0	-	417,0	25,0	-	-	-	-	-	-
Spanien	Jahr 2024	308,6	-	50,0	204,3	30,0	-	-	24,2	-	-
	Jahr 2023	308,6	-	50,0	204,3	30,0	-	-	24,2	-	-
Schweiz	Jahr 2024	153,6	-	-	153,6	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	150,5	-	-	150,5	-	-	-	-	-	-
Kanada	Jahr 2024	200,7	-	-	68,9	1,9	-	-	130,0	-	-
	Jahr 2023	389,1	-	-	257,4	2,6	-	-	129,2	-	-
EU-Institutionen	Jahr 2024	63,9	-	-	-	-	63,9	-	-	-	-
	Jahr 2023	68,7	-	-	-	-	68,7	-	-	-	-

**Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen bei Öffentlichen Pfandbriefen
als auch Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt
1. Quartal 2024**

		Gesamtbetrag der mindestens 90 Tage rückständigen Leistungen					Gesamtbetrag dieser Forderungen, soweit der jeweilige Rückstand mindestens 5 % der Forderung beträgt				
		Summe	davon				Summe	davon			
			Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige		Zentralstaat	Regionale Gebietskörperschaften	Örtliche Gebietskörperschaften	Sonstige
Staat	1. Quartal	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten											
	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Hypothekendarlehen
1. Quartal 2024

Weitere Deckungswerte für Hypothekendarlehen nach § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b), § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c), § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4							
Staat	1. Quartal	Mio. €	davon		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 a) bis c)		Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 4
			Forderungen gem. § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 a) und b)		Insgesamt	davon	
			Insgesamt	davon gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013			
		Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €	Mio. €
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	1.030,0	-	-	-	-	1.030,0
	Jahr 2023	1.073,0	-	-	-	-	1.073,0
Deutschland	Jahr 2024	1.030,0	-	-	-	-	1.030,0
	Jahr 2023	1.073,0	-	-	-	-	1.073,0

Weitere Deckungswerte - Detaildarstellung für Öffentliche Pfandbriefe
1. Quartal 2024

Weitere Deckungswerte für Öffentliche Pfandbriefe nach § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2, § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b), § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4								
Staat	1. Quartal	Mio. €	davon		davon		davon	
			Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 a) bis b)		Forderungen gem. § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 4	
			Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013	Insgesamt	gedeckte Schuldverschreibungen gem. Art. 129 Verordnung (EU) Nr. 575/2013
Gesamtsumme - alle Staaten	Jahr 2024	-	-	-	-	-	-	-
	Jahr 2023	-	-	-	-	-	-	-

Veröffentlichung gemäß § 28 Abs. 1 S. 1 Nrn. 6, 7, 11, 12, 13, 14, 15 PfandBG und § 28 Abs. 2 S. 1 Nrn. 3, 4 PfandBG

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

1. Quartal 2024

Hypothekendarlehen		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe			
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	35.076,0	33.527,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe	%	98,8	99,6
§ 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)			
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	41.358,0	40.259,9
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 12 Abs. 1, die die Grenzen nach § 13 Abs. 1 S. 2, 2. Halbsatz überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
davon Gesamtbetrag der Werte nach § 19 Abs. 1, die die Grenzen nach § 19 Abs. 1 S. 7 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 2 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 3 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
Forderungen, die die Grenze nach § 19 Abs. 1 Nr. 4 überschreiten	(Mio. €)	-	-
§ 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12			
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse	%	89,9	90,1
§ 28 Abs. 1 Nr. 13			
Nettoanwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung	CAD	-	-
je Fremdwährung in Mio. Euro	CHF	-	-
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)			
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	261,2	198,6
	HKD	-	-
	JPY	-	-
	NOK	-	-
	SEK	46,8	45,5
	USD	-	-
	AUD	-	-
volumengewichteter Durchschnitt des Alters der Forderungen (verstrichene Laufzeit seit Kreditvergabe - seasoning)	Jahre	5,4	5,1
§ 28 Abs. 2 Nr. 4			
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf	%	54,0	54,1
§ 28 Abs. 2 Nr. 3			
durchschnittlicher gewichteter Beleihungsauslauf auf Marktwertbasis - freiwillige Angabe - (Durchschnitt)	%	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG			
Größe sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	340,6	30,6
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	177	26
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	878,5	885,0
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 2 Buchstabe c (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 19 Abs. 1 S. 1 Nr. 3 Buchstabe d (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

Kennzahlen zu umlaufenden Pfandbriefen und dafür verwendeten Deckungswerten

1. Quartal 2024

Öffentliche Pfandbriefe		Q1 2024	Q1 2023
Umlaufende Pfandbriefe	(Mio. €)	9.244,4	9.323,4
davon Anteil festverzinslicher Pfandbriefe § 28 Abs. 1 Nr. 13 (gewichteter Durchschnitt)	%	95,5	94,5
Deckungsmasse			
Deckungsmasse	(Mio. €)	11.606,7	12.443,4
davon Gesamtbetrag der Forderungen nach § 20 Abs. 1 und Abs. 2, die die Grenzen nach § 20 Abs. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 11	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 2 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12	(Mio. €)	-	-
Forderungen, die die Grenze nach § 20 Abs. 2 Nr. 3 überschreiten § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 12		-	-
davon Anteil festverzinslicher Deckungsmasse § 28 Abs. 1 Nr. 13	%	96,7	98,1
Nettobarwert nach § 6 Pfandbrief-Barwertverordnung je Fremdwährung in Mio. Euro			
§ 28 Abs. 1 Nr. 14 (Saldo aus Aktiv-/Passivseite)	CAD	23,5	25,6
	CHF	52,4	50,8
	CZK	-	-
	DKK	-	-
	GBP	24,3	22,5
	HKD	-	-
	JPY	24,9	28,4
	NOK	-	-
	SEK	-	-
	USD	-86,9	15,7
	AUD	-	-
Kennzahlen zur Liquidität nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 6 PfandBG			
Größte sich innerhalb der nächsten 180 Tage ergebende negative Summe im Sinne des § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG für Pfandbriefe (Liquiditätsbedarf)	(Mio. €)	233,9	162,7
Tag, an dem sich die größte negative Summe ergibt	Tag (1-180)	84	41
Gesamtbetrag der Deckungswerte, welche die Anforderungen von § 4 Abs. 1a S. 3 PfandBG erfüllen (Liquiditätsdeckung)	(Mio. €)	869,9	1.228,0
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 7 PfandBG			
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den Deckungsmassen gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 1 (Bonitätsstufe 3)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 2 (Bonitätsstufe 2)	%	-	-
Anteil der Derivategeschäfte an den zu deckenden Verbindlichkeiten gemäß § 20 Abs. 2 S. 1 Nr. 3 Buchstabe c (Bonitätsstufe 1)	%	-	-
Kennzahlen nach § 28 Abs. 1 S. 1 Nr. 15 PfandBG			
Anteil der Deckungswerte an der Deckungsmasse, für die oder für deren Schuldner ein Ausfall gemäß Art. 178 Absatz 1 CRR als eingetreten gilt.	%	-	-

**Liste internationaler Wertpapierkennnummern der Internationalen Organisation für Normung (ISIN) nach Pfandbriefgattung
1. Quartal 2024**

Hypothekendarlehen		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	DE000A1REY59, DE000A12T2F9, DE000A12UGG2, DE000A13SR38, DE000A13SWZ1, DE000A14J5J4, DE000A14KKK3, DE000A14KKM9, DE000A14KKZ4, DE000A161ZQ3, DE000A2AASB4, DE000A2AAW12, DE000A2AAW53, DE000A2AAX03, DE000A2AAX11, DE000A2AAX45, DE000A2AAX60, DE000A2BPI78, DE000A2BPI86, DE000A2E4UX0, DE000A2GSMH3, DE000A2GSMJ9, DE000A2GSMK7, DE000A2GSP31, DE000A2GSP49, DE000A2GSP56, DE000A2GSP64, DE000A2GSP80, DE000A2GSP98, DE000A2G9HD6, DE000A2G9HE4, DE000A2G9HF1, DE000A2G9HG9, DE000A2G9HJ3, DE000A2G9HK1, DE000A2G9HL9, DE000A2G9HM7, DE000A2G9HN5, DE000A2G9HQ8, DE000A2NB841, DE000A2TSDV6, DE000A2TSDW4, DE000A2TSDY0, DE000A2TSD06, DE000A288367, DE000A289PA7, DE000A289PB5, DE000A289PC3, DE000A289PD1, DE000A289PE9, DE000A289PG4, DE000A289PH2, DE000A3E5UT4, DE000A3E5UU2, DE000A3E5UY4, DE000A3E5U22, DE000A3H2TK9, DE000A3H2TQ6, DE000A3H2TR4, DE000A3MP601, DE000A3MP619, DE000A3MP635, DE000A3MP643, DE000A3MP650, DE000A3MP668, DE000A3MP684, DE000A3MP692, DE000A3MQUV7, DE000A3MQUX3, DE000A3MQUY1, DE000A3MQZ8, DE000A3MQJ03, DE000A3MQU29, DE000A3MQJ37, DE000A3MQJ45, DE000A3MQJ52, DE000A3MQJ78, DE000A3MQJ86, DE000A3MQJ94, DE000A351XK8, DE000A351XL6, DE000A351XM4, DE000A351XS1, DE000A351XT9, DE000A351XU7, DE000A351XV5	DE000A0SMD13, DE000A1REY26, DE000A1REY59, DE000A1REZE1, DE000A1TNEQ7, DE000A1TNEX3, DE000A1X3M51, DE000A12T2F9, DE000A12T6Z8, DE000A12UGG2, DE000A13SR38, DE000A13SWZ1, DE000A14J5J4, DE000A14KKH9, DE000A14KKK3, DE000A14KKM9, DE000A14KKZ4, DE000A161ZL4, DE000A161ZQ3, DE000A2AASB4, DE000A2AAW12, DE000A2AAW53, DE000A2AAX03, DE000A2AAX11, DE000A2AAX45, DE000A2AAX60, DE000A2BPI45, DE000A2BPI78, DE000A2BPI86, DE000A2E4UX0, DE000A2GSMH3, DE000A2GSMJ9, DE000A2GSMK7, DE000A2GSP31, DE000A2GSP49, DE000A2GSP56, DE000A2GSP64, DE000A2GSP80, DE000A2GSP98, DE000A2G9HC8, DE000A2G9HD6, DE000A2G9HE4, DE000A2G9HF1, DE000A2G9HG9, DE000A2G9HJ3, DE000A2G9HK1, DE000A2G9HL9, DE000A2G9HM7, DE000A2G9HN5, DE000A2G9HQ8, DE000A2NB841, DE000A2TSDV6, DE000A2TSDW4, DE000A2TSDY0, DE000A2TSD06, DE000A288367, DE000A289PA7, DE000A289PB5, DE000A289PC3, DE000A289PD1, DE000A289PE9, DE000A289PG4, DE000A289PH2, DE000A3E5UT4, DE000A3E5UU2, DE000A3E5UY4, DE000A3E5U22, DE000A3H2TK9, DE000A3H2TQ6, DE000A3H2TR4, DE000A3MP601, DE000A3MP619, DE000A3MP635, DE000A3MP643, DE000A3MP650, DE000A3MP668, DE000A3MP684, DE000A3MP692, DE000A3MQUV7, DE000A3MQUX3, DE000A3MQUY1, DE000A3MQZ8, DE000A3MQJ03, DE000A3MQJ29, DE000A3MQJ37, DE000A3MQJ45, DE000A3MQJ52, DE000A3MQJ78, DE000A3MQJ86, DE000A3MQJ94, DE000A351XK8, DE000A351XL6, DE000A351XM4, DE000A351XS1, DE000A351XT9, DE000A351XU7, DE000A351XV5

Öffentliche Pfandbriefe		
	Q1 2024	Q1 2023
ISIN	DE000A0DLV76, DE000A0EUMF2, DE000A0EUMR7, DE000A0EUM42, DE000A0EUPJ7, DE000A1TM6A4, DE000A12TYS2, DE000A14J5C9, DE000A161ZP5, DE000A2BPI11, DE000A2BPI29, DE000A2BPI52, DE000A2BPI60, DE000A2GSMC4, DE000A2TSDZ7, DE000A3MQJ11, DE000A3MQJ60, DE000A351XN2, DE000A351XP7, DE000A351XQ5, DE000A351XR3	DE000A0DLV76, DE000A0EUMF2, DE000A0EUMR7, DE000A0EUM34, DE000A0EUM42, DE000A0EUPJ7, DE000A0XFAE1, DE000A1TM6A4, DE000A1YC8G2, DE000A1YCBK4, DE000A12TYS2, DE000A14J5C9, DE000A161ZP5, DE000A2BPI11, DE000A2BPI29, DE000A2BPI52, DE000A2BPI60, DE000A2GSMC4, DE000A2TSDZ7